

UAB25087 ECONOMETRIC MODELS

PROGRAMA

1. El modelo de regresión. Principales resultados
2. Interpretando y comparando. Modelos de regresión
 - 2.1. Interpretando el modelo lineal
 - 2.2. Errores de especificación
 - 2.3. Selección de modelos
 - 2.4. Aplicaciones
3. Endogeneidad y variables instrumentales
 - 3.1. Revisión de las propiedades del estimador de MQO
 - 3.2. El estimador de variables instrumentales
 - 3.3. Test de exogeneidad de Hausman
 - 3.4. Aplicaciones
4. Modelos de series de temporales univariantes
 - 4.1. Estacionariedad. La función de autocorrelación
 - 4.2. Procesos ARMA
 - 4.3. Estacionariedad y raíces unitarias
 - 4.4. Test de raíces unitarias
 - 4.5. Identificación de Modelos ARMA
 - 4.6. Estimación de modelos ARMA
 - 4.7. Predicción
 - 4.8. Aplicaciones
5. Modelos de series temporales multivariantes
 - 5.1. Modelos dinámicos con variables estacionarias
 - 5.2. Modelos con variables no estacionarias
 - 5.2.1. Regresión espuria
 - 5.2.2. Cointegración
 - 5.2.3. Cointegración y mecanismos de corrección de error
 - 5.2.4. Aplicaciones

BIBLIOGRAFIA

- Greene, W.H. (1997), "Econometric analysis", Prentice-Hall
- Johnston, J y Dinardo, J (1997), "Econometric methods", McGraw-Hill
- Verbeck, M. (2000), "A guide to modern econometrics", John Wiley and Sons